

DAILY SIGNAL 上田八木短資株式会社

TEL:0120-327-017

平成30年11月5日(月)

短期市場の推移

[億円] [%]

11月6日の予定(時刻は日本時間)

	10月30日	10月31日	11月1日	11月2日
加重平均金利	▲0.072	▲0.068	▲0.071	▲0.071
東京レポレート(ON)	▲0.134	▲0.125	▲0.139	▲0.115
無コール残	81,957	66,848	86,584	91,293
ON	49,212	34,528	54,064	56,623
その他	32,745	32,320	32,520	34,670
有コール残	14,219	11,652	14,035	17,912

	日本	予想	海外	予想
-	【記者会見】黒田総裁(11月5日)	-	0:00	(米)10月ISM非製造業景況指数
-	-	-	19:00	(欧)9月生産者物価指数[前年比]
-	-	-	-	-

加重平均金利・コール残高は日銀、東京レポレートは日本証券業協会公表
※加重平均金利は無担保コールONのもの。無・有コール残は無担保・有担保コール残高の意。

経済指標及び予想値は株式会社フィスコ提供

本日の短期市場金利

[%]

	無担保コール(速報)			レポ市場
	最低	最高	平均	東京レポレート
O/N	▲0.086	0.001	▲0.072	▲0.113
T/N	-	-	▲0.010	▲0.131
S/N	-	-	-	-
1W	▲0.045	▲0.035	▲0.042	▲0.134
2W	-	-	▲0.045	▲0.136
3W	-	-	-	▲0.139
1M	-	-	-	▲0.143
2M	-	-	-	-
3M	-	-	-	▲0.150
6M	-	-	-	▲0.151
1Y	-	-	-	▲0.158

本日の市況

無担保コールON物は▲0.085%の出合から始まった。その後は、主に▲0.086%~▲0.040%の水準で取引された。同加重平均金利(速報値)は前営業日対比▲0.001%の▲0.072%となった。

都銀・信託	証券	地銀
▲0.086 ~ ▲0.086	- ~ -	▲0.086 ~ ▲0.055

翌営業日のマーケット

本日と同様に調達サイドが慎重な姿勢となり、軟調な地合いを予想する。

無担保コール(速報)は日銀、東京レポレートは日本証券業協会公表

資金需給

[億円]

	日銀速報		日銀予想		当社需給予想	
	11月5日	11月6日	11月6日	11月7日	11月7日	11月8日
券	+900	+700	+900	+700	+1,000	+1,000
財政	▲3,500	+700	▲3,500	+700	▲4,000	▲4,000
過不足	▲2,600	+1,400	▲2,600	+1,400	▲3,000	▲3,000
金融調節	エンド	スタート	エンド	スタート	エンド	スタート
国債買入	+12,200	+3,100	+12,200	+3,100	+	+
共通担保(全店)	▲1,500	+1,800	▲1,500	+1,800	+	+
CP等買入	▲100	-	▲100	-	+	+
社債等買入	-	-	-	-	+	+
国債補完供給	+200	▲400	+200	▲400	+	+
当座預金増減	+9,600	+4,800	+9,600	+4,800	▲3,000	▲3,000
当座預金残高	3,917,700	3,922,500	3,917,700	3,922,500	3,919,500	3,919,500
準備預金残高	3,433,100	3,432,600	3,433,100	3,432,600	3,432,600	3,432,600
積み終了先	3,432,600	3,432,600	3,432,600	3,432,600	3,432,600	3,432,600
超過準備	3,432,600	3,432,600	3,432,600	3,432,600	3,432,600	3,432,600
非準備預金残高	484,600	484,600	484,600	484,600	484,600	484,600
準備預金進捗率	99.9%	99.9%	99.9%	99.9%	99.9%	99.9%
平均	67.7%	67.7%	67.7%	67.7%	67.7%	67.7%
乖離率	32.2%	32.2%	32.2%	32.2%	32.2%	32.2%

11月5日のオペ結果 [%][億円] ※米ドル資金供給は百万\$

オペ種類	オファー	応札	落札	足切	平均	接分
国債買入(11/6~)						
~1年	500	2,089	500	0.021	0.021	
10~25年	1,800	5,715	1,806	0.004	0.004	69.6
25年~	500	1,783	508	0.006	0.007	10.7
国債補完供給(11/5~11/6)						
89,054	338	338	▲0.600	▲0.600		
38,180	8	8	▲0.600	▲0.600		

マナタリーベース [億円]	所要 [億円]
11月2日時点 5,007,900	今積期の所要準備額 3,102,700
	11月6日以降の残り所要積数 2,700
	平均 300

国庫短期証券入札予定

11月8日	16ヶ月
11月9日	3ヶ月
11月16日	3ヶ月
11月19日	1年
11月6日	物価連動
11月13日	30年
11月15日	5年
11月20日	20年

今月の国債買入オペ予定

オペ種類	一回当たりオファー金額	直近オファー額	オファー予定日	直近日	残り回数
1年以下	100~1,000 程度	500	月2回程度	11月5日	1
1年超3年以下	2,500~4,500 程度	3,500			
3年超5年以下	3,000~5,500 程度	4,000	9 19 28	11月2日	3
5年超10年以下	3,000~6,000 程度	4,500	2 12 16 26 30	11月2日	4
10年超25年以下	1,500~2,500 程度	1,800			
25年超	100~1,000 程度	500	5 9 16 26 30	11月5日	4
物価連動債	250 程度	250	月2回程度	10月19日	2
変動利付債<偶数月>	1,000 程度	1,000	1回	10月17日	1

1年前の市場推移

○2017年10月積み期 [10月16日~11月15日]

※積み初日及び積み最終日が祝日・休日の場合は、前営業日のレート・残高を記載しています。



本資料は投資環境等に関する情報提供を目的として作成したものです。本資料は投資勧誘を目的とするものではありません。有価証券等の取引には、リスクが伴います。投資についての最終決定は、投資家ご自身の判断と責任においてなされるようお願いいたします。当社は、いかなる投資の妥当性についても保証するものではありません。記載された意見や予測等は作成時点のものであり、正確性、完全性を保証するものではなく、今後予告なく変更されることがあります。